27009 - Introducción a la Econometría

Centro: Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales

Titulación: Grado en Economía

Curso académico: 2015/16

Curso: 3

Descripción y Contextualización de la Asignatura

No hay información disponible sobre esta sección

Competencias/ Resultados de aprendizaje de la asignatura

Objetivos: Es un curso introductorio a la Econometría en el que se estudia en detalle el Modelo de Regresión Lineal General. El objetivo principal del curso consiste en que los estudiantes sean capaces de utilizar un modelo de regresión para resolver un problema económico sencillo tanto desde una perspectiva teórica como desde el punto de vista práctico. Más concretamente, al final del curso los estudiantes serán capaces de utilizar herramientas de análisis y programas informáticos con el fin de cuantificar y validar las relaciones económicas relevantes a la hora de explicar un cierto fenómeno económico a través de la estimación y el contraste de un modelo econométrico ajustado a los datos disponibles.Competencias especificas: 1. Analizar los elementos básicos de la Econometría para comprender la lógica de la modelización econométrica y ser capaz de especificar de forma crítica relaciones causales entre variables económicas. 2. Identificar las fuentes estadísticas pertinentes a fin de ser capaz de buscar y organizar de manera sistemática los datos económicos disponibles relevantes para explicar un cierto fenómeno económico.3. Utilizar la metodología econométrica básica y adquirir destreza en el uso de los instrumentos informáticos apropiados para estimar y validar relaciones económicas. 4. Manejar las herramientas econométricas de predicción para estimar valores desconocidos o futuros de una variable económica. 5. Interpretar adecuadamente los resultados obtenidos con el fin de elaborar informes significativos y coherentes sobre el comportamiento de los datos económicos.Competencias transversales:1. Saber buscar, analizar y sintetizar información proveniente de diversas fuentes con capacidad crítica, autocrítica y de aprendizaje autónomo, para emitir juicios razonados sobre temas relevantes de índole económica, social o científica (G004 DEL GRADO).2. Elaborar informes y transmitir ideas sobre cualquier materia económica, con claridad y coherencia, a un público tanto especializado como no especializado, haciendo uso de la competencia idiomática requerida en cada caso (G006 DEL GRADO).3. Saber integrarse en grupos de trabajo multidisciplinares, desarrollando las habilidades requeridas para cada situación: trabajo en equipo, liderazgo, iniciativa, creatividad, o toma de decisiones (G005 DEL GRADO).Competencias generales del perfil de la titulación:1. Aplicar los conocimientos teóricos y prácticos adquiridos en el diagnóstico y resolución de problemas, empleando los instrumentos analíticos oportunos en la toma de decisiones (G002 DEL GRADO).2. Ser capaz de abstraer los aspectos básicos de la realidad económica a través de modelos matemáticos identificando los factores relevantes en el diseño de los mismos (G009 DEL GRADO).3. Manejar las técnicas cuantitativas en la interpretación de datos económicos y su cuantificación, y comprender la relación entre el análisis verbal, gráfico, matemático y econométrico en el estudio de la economía (G010 DEL GRADO). 4. Utilizar eficazmente las tecnologías de la información y los instrumentos informáticos relativos al ámbito de estudio (G003 DEL GRADO).

Contenidos Teórico-Prácticos

1. Introducción a la Econometría.Elementos de la Econometría. Concepto de modelo: Modelo económico y Modelo econométrico. Ejemplo. El término de error. Tipos de datos. Variables cuantitativas y cualitativas. Variables ficticias: Ejemplos. Etapas en la elaboración de un modelo. Usos del modelo. 2. Modelo de Regresión Lineal General (I): Especificación.Especificación del MRLG: supuestos básicos. Forma funcional. Cambios de escala y origen. Variables ficticias: utilización en el MRLG. Interpretación de los coeficientes de variables cuantitativas. Interpretación de los coeficientes de variables ficticias. Interacción entre variables cuantitativas y ficticias.3. Modelo de Regresión Lineal General (II): Estimación.Estimador de Mínimos Cuadrados Ordinarios (MCO): Ejemplo. Propiedades de la función de regresión muestral. Bondad del ajuste: el coeficiente de determinación: Ejemplo. Estimador de la varianza de las perturbaciones. Propiedades en muestras finitas del estimador MCO: el teorema de Gauss Markov. Estimación mínimo-cuadrática sujeta a restricciones.4. Modelo de Regresión Lineal General (III): Inferencia y predicción.Distribución del estimador MCO bajo normalidad. Contrastes de significatividad individual. Contrastes con variables cualitativas. Estimación por intervalo. Contraste general de restricciones lineales. Contrastes basados en la suma de cuadrados de los residuos. Contrastes de significatividad conjunta. Problemas de especificación. Multicolinealidad: Ejemplo. Predicción por punto y por intervalo.

Metodología

La metodología docente se basará en cuatro tipo de sesiones lectivas: clases magistralesen las que se desarrollarán los distintos temas del programa del curso, explicando losconceptos e ilustrándolos con ejemplos, clases prácticas en el aula donde se realizaránejercicios y problemas para afianzar los conceptos del curso, clases prácticas conordenador en el laboratorio de informática donde se procederá a utilizar los instrumentosinformáticos

disponibles para el análisis econométrico y seminarios donde se comentaránlecturas y presentaciones de trabajos. Las clases prácticas en los laboratoriosinformáticos se llevarán a cabo con la ayuda de software econométrico (preferentemente decódigo abierto, p. ej. Gretl, disponible gratuitamente en la página webhttp://gretl.sourceforge.net, u otros tales como R, Excel, etc.) Plataforma de apoyo a ladocencia: Existe un curso virtual de apoyo a la asignatura creado con la plataforma deapoyo docente Moodle. En él se encuentran a disposición de los alumnos los materialesdidácticos utilizados a lo largo del curso (contenidos, horarios, ejercicios, apuntes,lecturas, datos, etc.). Además, el alumno podrá utilizar este curso virtual de formainteractiva para la resolución y entrega de tareas individuales y en grupo, así como paraparticipar en el foro de discusión de la asignatura, en las tutorías virtuales y/o en laconfección de un Wiki sobre fuentes estadísticas entre otras cosas. Material didáctico:Diapositivas, notas de clase y documentos a disposición del alumno en la página web de laasignatura. Trabajo escritos: Los ejercicios prácticos serán proporcionados y discutidosen las clases. Los estudiantes pueden ser requeridos a entregar respuestas escritas aproblemas tanto directamente como a través de la plataforma virtual de apoyo docente.

Tipo de docencia

Tipo de docencia	M (Magistral)	S (Seminario)	GA (P. de Aula)	GL (P. Laboratorio)	GO (P. Ordenador)	GCL (P. Clínicas)	TA (Taller)	TI (Taller Ind.)	GCA (P. de Campo)
Horas de docencia presencial	42	9	9						
Horas de actividad no presencial del alumno / alumna	60	18	12						

Sistemas de evaluación

SISTEMA DE EVALUACIÓN MIXTA

SISTEMA DE EVALUACIÓN FINAL

Herramientas y porcentajes de calificación:

PRUEBA ESCRITA A DESARROLLAR 70%

REALIZACIÓN DE PRACTICAS (EJERCICIOS, CASOS O PROBLEMAS) 20%

EXPOSICIÓN DE TRABAJOS, LECTURAS... 10%

Convocatoria Ordinaria: Orientaciones y Renuncia:

Se evaluarán todas las competencias anteriormente indicadas mediante diferentes actividades. La nota final se obtendrá de:- Actividades realizadas en clase, resolución de ejercicios individuales y/o en grupo y actividades virtuales: 30% de la nota final.- Prueba escrita (en la fecha oficial): 70% de la nota final. Para superar la materia es requisito obtener al menos 4 puntos del total de 10 puntos en la prueba escrita final.Aquellos alumnos que sean evaluados mediante evaluación continua, recibirán la calificación de "No Presentado" si no se presentan a la prueba final. Por tanto, la calificación de "No presentado" implica la renuncia voluntaria a la correspondiente convocatoria.El alumno que, por las causas justificadas recogidas en la normativa de evaluación, desee estar exento de evaluación continua deberá solicitarlo en Decanato en los plazos previstos para ello.La evaluación para aquellos estudiantes que en primera convocatoria estén exentos del sistema de evaluación continua y para los que se presenten a la segunda convocatoria de cada curso académico será, en todo caso, una prueba final que determinará el 100% de la calificación. En esta prueba se evaluarán todas las competencias y contenidos desarrollados en las actividades del periodo de docencia presencial de la asignatura.

Convocatoria Extraordinaria: Orientaciones y Renuncia

No hay información disponible sobre esta sección

Bibliografía

Bibliografía básica:

1. AFG: Alonso, Fernández y Gallastegui (2004), Econometría, Prentice-Hall (Pearson); ISBN: 84-205-4460-4.2. AFG: Alonso, Fernández y Gallastegui (2010), Ekonometria, UPV/EHU; ISBN: 84-986-0358-7.3. Fernández J. y González P.: Introducción a la Econometría, EHU OpenCourseWare, Creative Commons, (hyperlink: ocw.ehu.es, [2009/03][Cas]).4. Fernández J.: Introductory Econometrics, EHU OpenCourseWare, Creative Commons, (hyperlink: ocw.ehu.es, [2009/03][Eng]).5. Wooldridge, J.M., (2001), Introducción a la econometría: Un enfoque moderno, Thomson-Paraninfo.

Bibliografía profundización:

1. Gujarati, D., (2003), Basic Econometrics, 4ª ed., McGraw-Hill.2. Ramanathan, R., (2002), Introductory Econometrics with Applications, 5ªed., SouthWestern.3. Dougherty, C., (2007), Introduction to Econometrics, 3ª ed., Oxford University Press.4. Stock, J. y Watson, M., (2008), Introduction to Econometrics, 2ª ed., Pearson Education.5. Wooldridge, J.M., (2003), Introductory Econometrics: A modern approach, 2ª ed., Thomson.

Revistas:

Español:- http://www.revecap.com: Revista de Economía Aplicada- http://www.revistaestudiosregionales.com: Revista de Estudios Regionales- http://www.funep.es/invecon/sp/sie.asp: Investigaciones Económicas- http://www1.euskadi.net/ekonomiaz: EkonomiazEnglish:- Computational Economics- Econometrica- Econometric Reviews- Econometric Theory- Empirical Economics Journal- International Journal of Forecasting- Journal of Applied Econometrics- Journal of Business and Economic Statistics- Journal of Econometrics- Journal of Economic Dynamics and Control- Journal of Forecasting- Oxford Bulletin of Economics and Statistics- Review of Economics and Statistics- Review of Economic Studies- Studies in Nonlinear Dynamics and Econometrics...y muchas otras, consulta UPV/EHU biblioteca—revistas electrónicas.

Direcciones de Internet de interés:

- http://moodle.ehu.es/IEcnometríaSoftware:- http://gretl.sourceforge.net. Gretl: Software econométrico de código abierto y gratuito (versiones en Español, Euskara e Inglés), manual de usuario y datos.Instituciones:- http://www.eustat.es. EUSTAT- http://www.ine.es. INE- http://www.bde.es. Banco de España- http://ec.europa.eu/eurostat. EUROSTAT- http://www.oecd.org OCDE- http://www.imf.org. International Monetary Fund-

http://www.worldbank.org. World Bank- http://www.bolsamadrid.es Madrid Stock MarketDatos:- http://www.nber.org/data_index.html- http://www.estadief.minhac.es/- http://fisher.osu.edu/fin/osudown.htm- http://econ.queensu.ca/jae/- http://www.psidonline.isr.umich.edu/data/- http://www.census.gov/

Observaciones

No hay información disponible sobre esta sección
Fecha última modificación: 26/06/2015